

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2018

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2018)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	30.664.629,42	8,06%	674	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	31.025.277,83	8,15%	741	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.091.495,31	5,54%	1.457	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	53.338.385,48	14,02%	715	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	28.894.213,87	7,59%	1.264	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	11.372.299,60	2,99%	51	3,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	541.813,12	0,14%	442	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.305.472,06	0,61%	26	2,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	15.184.127,45	3,99%	88	9,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	33.769.593,01	8,88%	809	0,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA ...	D+4	Não há	3.319.519,17	0,87%	7	12,51%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	3.939.043,11	1,04%	21	11,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	7.359.124,89	1,93%	31	1,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.440.651,11	2,48%	23	8,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.858.491,57	3,12%	456	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	13.683.974,46	3,60%	59	0,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.653.573,28	0,70%		3,58%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	1008 dias úteis	6.230.715,18	1,64%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	317.705,14	0,08%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.921.520,68	1,29%	2.033	3,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

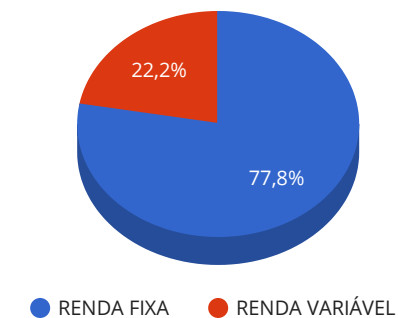
Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2018)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	5.956.582,22	1,57%	1.941	5,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.878.150,00	1,81%	76	4,95%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.921.520,68	1,29%	2.033	3,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	4.389.231,75	1,15%	198	3,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.026.017,22	1,58%	202	4,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	3.455.159,23	0,91%	214	5,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.000.879,28	0,26%	132	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	937.547,35	0,25%	1.804	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.076.302,80	1,07%	75	2,96%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou...	Não há	4.583.799,28	1,20%	11	6,36%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	11.231.313,34	2,95%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	13.955.131,36	3,67%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se ...	Não se aplica	1.168.649,00	0,31%		0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	6.096.773,34	1,60%		2,95%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	8.195.951,10	2,15%		4,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.509.618,33	1,45%	9	19,54%	Desenquadrado - RF
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.403.495,28	0,89%	10	6,12%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			380.483.096,33				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2018)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2018			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	176.386.301,51	46,36%	15,00%	25,00%	70,00%	89.951.865,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	228.289.857,80
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	101.401.809,95	26,65%	5,00%	10,00%	30,00%	12.743.118,95
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	57.072.464,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	9.201.993,60	2,42%	2,00%	5,00%	5,00%	9.822.161,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	19.024.154,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.024.154,82
Desenquadrado - RF	0,00%	8.913.113,61	2,34%	0,00%	0,00%	0,00%	-8.913.113,61
Total Renda Fixa	100,00%	295.903.218,67	77,77%	36,00%	70,00%	190,00%	

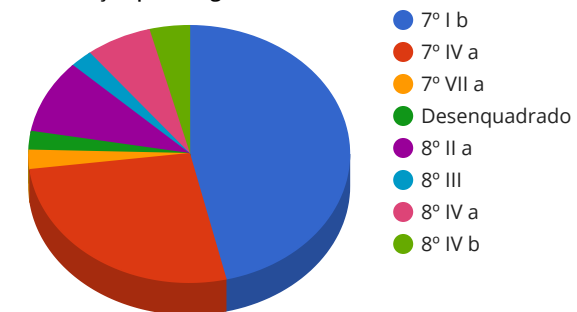
Distribuição por Segmento



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2018)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2018			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	38.048.309,63
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	35.271.957,44	9,27%	2,00%	5,00%	10,00%	2.776.352,19
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.660.102,08	2,28%	7,00%	10,00%	10,00%	29.388.207,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	25.186.444,70	6,62%	2,00%	5,00%	5,00%	-6.162.289,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	15.461.373,44	4,06%	2,00%	5,00%	5,00%	3.562.781,38
Total Renda Variável	30,00%	84.579.877,66	22,23%	15,00%	30,00%	40,00%	

Distribuição por Artigos



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Agosto / 2018)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	139.405.916,34	36,64	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	71.291.791,30	18,74	0,01
INFINITY ASSET MANAGEMENT	23.199.473,36	6,10	3,88
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	21.299.142,68	5,60	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	17.080.239,56	4,49	20,32
ITAÚ UNIBANCO	14.684.853,74	3,86	0,00
KINEA INVESTIMENTOS	13.955.131,36	3,67	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	12.834.732,22	3,37	7,49
A5 CAPITAL PARTNERS	11.231.313,34	2,95	-
MULTINVEST CAPITAL	8.829.137,50	2,32	6,81
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	7.359.124,89	1,93	0,05
ZION INVEST	6.096.773,34	1,60	1,24
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	6.026.017,22	1,58	-
PERFIN INVESTIMENTOS	4.921.520,68	1,29	0,13
CAPITÂNIA	4.583.799,28	1,20	0,07
META ASSET MANAGEMENT	4.389.231,75	1,15	2,60
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.455.159,23	0,91	0,88
AURORA CAPITAL	3.403.495,28	0,89	-
RJI CORRETORA DE VALORES	2.305.472,06	0,61	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.706.869,71	0,45	0,01
CREDIT SUISSE HEDGING-GRIFFO C...	1.168.649,00	0,31	-
NAVI CAPITAL	937.547,35	0,25	0,05
TRX	317.705,14	0,08	0,11

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	176.386.301,51	46,36	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	101.401.809,95	26,65	5,00	30,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00	7,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	9.201.993,60	2,42	2,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	35.271.957,44	9,27	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	8.660.102,08	2,28	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	25.186.444,70	6,62	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	15.461.373,44	4,06	2,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2018 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,61%	8,30%	3,57%	6,33%	12,46%	24,40%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-14,81%	8,66%	-12,16%	-10,31%	-4,94%	6,55%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,10%	4,72%	1,86%	3,28%	8,04%	23,52%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-14,41%	4,36%	-13,09%	-10,58%	-6,17%	2,79%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-14,41%	4,50%	-13,07%	-10,70%	-6,11%	2,93%	0,01%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,53%	7,62%	3,32%	5,83%	11,43%	22,12%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,65%	1.104,66%	-3,17%	-4,45%	-2,82%	651,72%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,44%	6,95%	3,06%	5,32%	10,39%	19,86%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-20,15%	3,51%	-18,45%	-15,72%	-9,22%	0,73%	0,03%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,52%	1,88%	1,50%	-3,46%	2,62%	19,51%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-12,76%	3,87%	-12,16%	-10,36%	-7,25%	0,28%	0,02%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	4,21%	1,65%	3,04%	6,90%	20,96%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-8,86%	4,04%	-8,12%	-6,71%	-3,52%	2,90%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-8,93%	4,08%	-8,18%	-6,75%	-3,53%	2,94%	0,00%	0,01%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2018 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,26%	4,06%	1,67%	2,14%	6,66%	21,49%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-16,51%	3,90%	-15,04%	-12,46%	-7,18%	2,01%	0,02%	0,03%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-7,10%	-19,73%	-4,87%	-3,94%	-2,46%	-21,57%	0,01%	0,15%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-10,20%	4,20%	-8,83%	-6,55%	-1,74%	2,41%	0,03%	0,06%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-18,09%	-10,15%	-16,79%	-15,27%	-5,18%	-7,79%	0,02%	0,07%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-3,65%	-11,27%	-3,28%	-2,06%	-1,35%	-12,62%	0,01%	0,09%

IMA-B (Benchmark)	-0,45%	3,04%	1,53%	-0,90%	4,57%	20,76%	-	-
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	-17,96%	2,62%	-17,42%	-13,44%	-10,29%	1,48%	0,02%	0,02%

Selic (Benchmark)	0,57%	4,33%	1,64%	3,24%	6,84%	19,73%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	-7,69%	4,26%	-7,01%	-5,85%	-2,94%	3,16%	0,00%	0,00%

CDI (Benchmark)	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	-7,56%	4,19%	-6,90%	-5,77%	-2,90%	3,15%	0,00%	0,00%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	-8,30%	4,76%	-7,53%	-6,33%	-3,49%	3,42%	0,00%	0,01%

IPCA (Benchmark)	-0,09%	2,85%	1,50%	2,22%	4,19%	6,75%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-13,72%	4,85%	-13,13%	-11,71%	-5,68%	2,56%	0,00%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-16,53%	3,20%	-15,46%	-13,39%	-7,95%	0,95%	0,02%	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2018 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-7,77%	4,12%	-7,06%	-5,84%	-2,91%	3,07%	0,00%	0,00%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-	-51,82%	-	0,32%	-4,52%	-38,47%	0,00%	0,09%

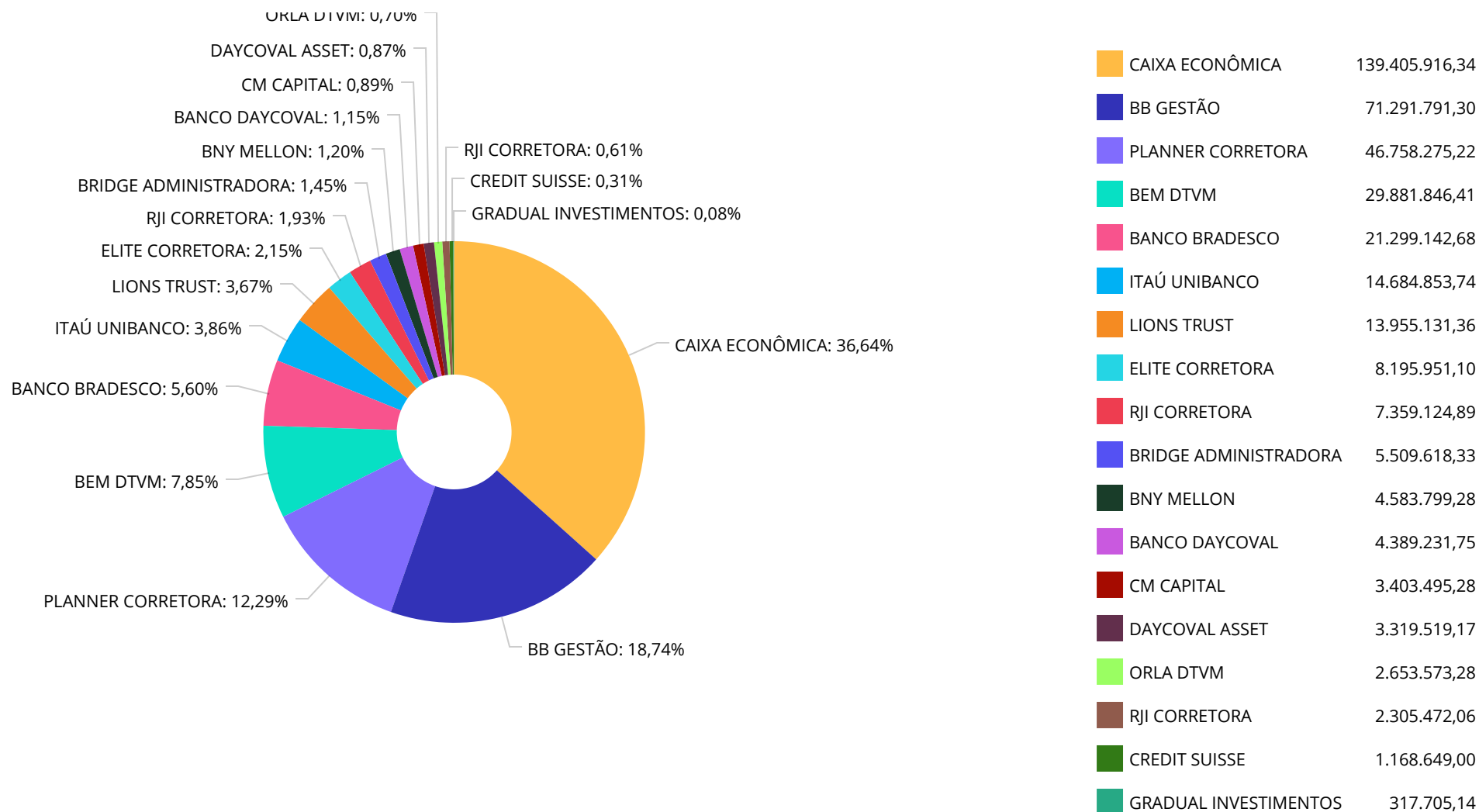
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2018 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	-3,70%	-3,80%	-1,17%	-11,91%	0,29%	33,84%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-36,03%	-1,44%	-30,78%	-25,57%	-18,84%	-9,71%	0,09%	0,14%
IBX (Benchmark)	-3,13%	-0,08%	-0,04%	-10,15%	7,35%	31,46%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-39,84%	1,67%	-30,51%	-24,87%	-22,57%	-11,04%	0,12%	0,23%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-37,17%	-1,51%	-32,36%	-28,35%	-21,48%	-9,45%	0,09%	0,16%
Ibovespa (Benchmark)	-3,21%	0,36%	-0,10%	-10,16%	8,25%	32,43%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-42,49%	-7,98%	-36,19%	-30,03%	-23,03%	-12,17%	0,08%	0,15%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-36,24%	7,36%	-28,82%	-26,24%	-18,82%	-7,48%	0,11%	0,20%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	-34,69%	5,35%	-29,57%	-24,39%	-19,99%	-6,65%	0,12%	0,20%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-46,06%	1,70%	-38,49%	-34,07%	-24,87%	-6,66%	0,09%	0,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-41,41%	4,76%	-34,48%	-32,24%	-22,07%	-4,57%	0,09%	0,17%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-39,19%	12,57%	-35,21%	-31,65%	-24,08%	-2,74%	0,10%	0,17%
CDI (Benchmark)	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	-8,02%	4,64%	-7,33%	-6,14%	-3,21%	3,47%	0,00%	0,01%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	32,25%	-2,50%	31,47%	16,69%	0,09%	-2,70%	0,01%	0,10%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

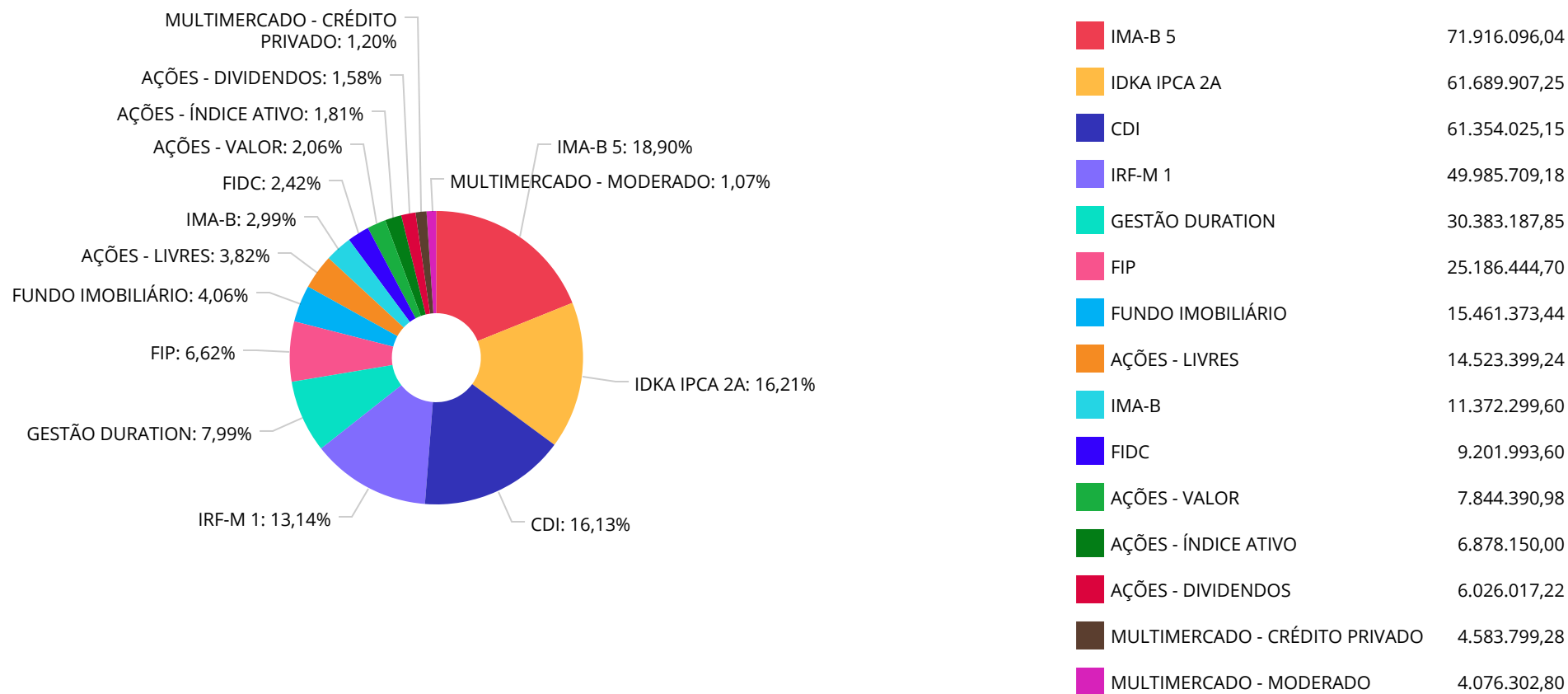
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2018 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-31,47%	-91,55%	-30,94%	-22,27%	-20,71%	-91,63%	0,06%	0,17%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	64,35%	-14,09%	80,00%	21,15%	11,18%	-7,80%	0,32%	0,95%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2018)



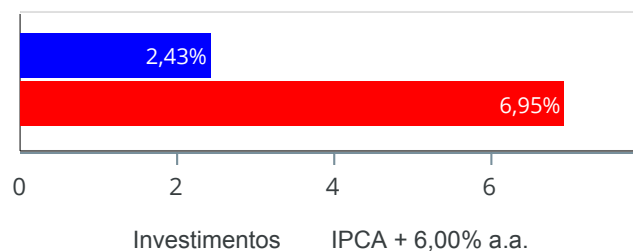
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2018)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	374.825.789,90	4.489.870,99	4.522.809,33	383.125.209,80	8.332.358,24	8.332.358,24	2,22%	2,22%	0,80%	0,80%	277,36%	1,85%
Fevereiro	383.125.209,80	2.815.145,97	2.972.073,72	384.468.549,47	1.500.267,42	9.832.625,66	0,39%	2,62%	0,74%	1,55%	169,70%	2,53%
Março	384.468.549,47	2.764.174,26	3.045.788,86	388.591.051,59	4.404.116,72	14.236.742,38	1,15%	3,80%	0,58%	2,13%	178,19%	2,56%
Abril	388.591.051,59	2.781.475,58	3.069.993,43	386.621.087,95	-1.681.445,79	12.555.296,59	-0,43%	3,35%	0,71%	2,85%	117,33%	3,15%
Mai	386.621.087,95	18.407.111,08	18.717.105,84	379.010.150,81	-7.300.942,38	5.254.354,21	-1,89%	1,40%	0,89%	3,77%	37,09%	3,05%
Junho	379.010.150,81	30.264.110,04	30.535.161,86	378.943.890,45	204.791,46	5.459.145,67	0,05%	1,45%	1,75%	5,59%	26,00%	3,94%
Julho	378.943.890,45	4.100.856,94	4.652.988,90	381.274.811,05	2.883.052,56	8.342.198,23	0,76%	2,22%	0,84%	6,48%	34,35%	2,83%
Agosto	381.274.811,05	55.351.844,93	56.917.927,58	380.483.096,33	774.367,93	9.116.566,16	0,20%	2,43%	0,44%	6,95%	35,01%	2,52%

Investimentos x Meta Atuarial



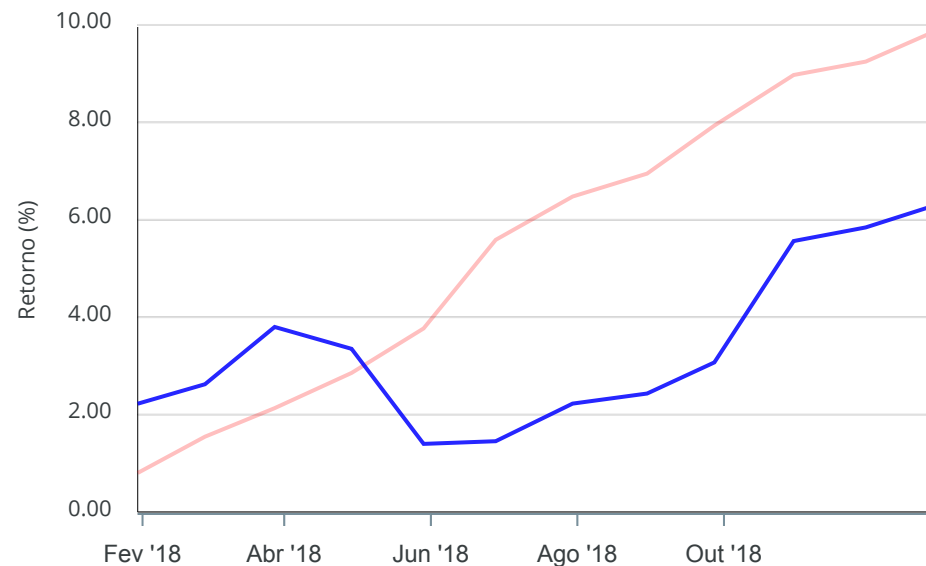
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2018

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	179.110,22	0,00	0,00	2.653.573,28	2.474.463,06	1.381,53%	-	-
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	314.619,70	0,00	0,00	317.705,14	3.085,44	0,98%	0,98%	0,04%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	6.180.442,89	0,00	0,00	6.230.715,18	50.272,29	0,81%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	539.022,85	0,00	0,00	541.813,12	2.790,27	0,52%	0,52%	0,05%
INFINITY LÔTUS FI RENDA FIXA LP	15.112.903,76	0,00	0,00	15.184.127,45	71.223,69	0,47%	0,47%	0,22%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	11.810.489,99	0,00	11.858.491,57	48.001,58	0,41%	0,55%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	28.900.904,53	0,00	120.818,06	28.894.213,87	114.127,40	0,39%	0,40%	0,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	13.633.028,59	0,00	0,00	13.683.974,46	50.945,87	0,37%	0,37%	0,23%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	64.772.573,72	2.963.773,75	34.206.137,04	33.769.593,01	239.382,58	0,35%	0,56%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	29.193.444,85	0,00	8.196.012,80	21.091.495,31	94.063,26	0,32%	0,41%	0,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.111.574,74	0,00	1.114.932,17	0,00	3.357,43	0,30%	-0,46%	3,48%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	13.233.630,50	0,00	13.273.139,01	0,00	39.508,51	0,30%	-0,48%	3,49%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FI...	3.318.488,56	0,00	0,00	3.319.519,17	1.030,61	0,03%	0,03%	1,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	30.663.022,24	0,00	0,00	30.664.629,42	1.607,18	0,01%	0,01%	1,41%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	29.936.951,30	1.114.932,17	0,00	31.025.277,83	-26.605,64	-0,09%	-0,08%	1,43%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.311.890,40	0,00	0,00	2.305.472,06	-6.418,34	-0,28%	-0,28%	1,19%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	3.950.545,53	0,00	0,00	3.939.043,11	-11.502,42	-0,29%	-0,29%	2,47%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.528.911,92	0,00	0,00	5.509.618,33	-19.293,59	-0,35%	-0,35%	3,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	11.417.919,18	0,00	0,00	11.372.299,60	-45.619,58	-0,40%	-0,40%	3,37%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.018.270,77	6.462.649,02	0,00	9.440.651,11	-40.268,68	-0,42%	-0,36%	1,84%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2018

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	20.578.846,10	33.000.000,00	0,00	53.338.385,48	-240.460,62	-0,45%	-0,27%	1,98%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.398.853,75	0,00	0,00	7.359.124,89	-39.728,86	-0,54%	-0,53%	0,85%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.423.977,93	0,00	0,00	3.403.495,28	-20.482,65	-0,60%	-0,60%	2,30%
Total Renda Fixa	294.718.934,03	55.351.844,93	56.911.039,08	295.903.218,67	2.743.478,79	0,78%		1,11%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2018

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.055.862,43	0,00	0,00	4.076.302,80	20.440,37	0,50%	0,50%	0,11%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.561.104,78	0,00	0,00	4.583.799,28	22.694,50	0,50%	0,50%	0,99%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	8.201.633,76	0,00	0,00	8.195.951,10	-5.682,66	-0,07%	-0,07%	0,00%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	13.967.630,02	0,00	0,00	13.955.131,36	-12.498,66	-0,09%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	11.252.085,84	0,00	0,00	11.231.313,34	-20.772,50	-0,18%	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.188.715,50	0,00	6.888,50	1.168.649,00	-13.178,00	-1,11%	-0,40%	5,59%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6.126.132,93	0,00	0,00	5.956.582,22	-169.550,71	-2,77%	-2,77%	8,53%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	7.088.919,57	0,00	0,00	6.878.150,00	-210.769,57	-2,97%	-2,97%	11,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.039.433,03	0,00	0,00	1.000.879,28	-38.553,75	-3,71%	-3,71%	8,61%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.113.029,88	0,00	0,00	4.921.520,68	-191.509,20	-3,75%	-3,75%	7,92%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.787.681,75	0,00	0,00	1.706.869,71	-80.812,04	-4,52%	-4,52%	11,33%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	985.343,44	0,00	0,00	937.547,35	-47.796,09	-4,85%	-4,85%	9,67%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	3.633.833,52	0,00	0,00	3.455.159,23	-178.674,29	-4,92%	-4,92%	9,12%
META VALOR FI AÇÕES	4.620.910,05	0,00	0,00	4.389.231,75	-231.678,30	-5,01%	-5,01%	12,41%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	6.451.612,00	0,00	0,00	6.096.773,34	-354.838,66	-5,50%	-5,50%	32,09%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.481.948,52	0,00	0,00	6.026.017,22	-455.931,30	-7,03%	-7,03%	8,91%
Total Renda Variável	86.555.877,02	0,00	6.888,50	84.579.877,66	-1.969.110,86	-2,27%		9,32%